ITinvest investment company

ПРОСПЕКТ БРОКЕРСКАЯ ГРУППА

Ежедневный обзор рынка акций

21 марта 2011г.

Комментарий по рынку акций

В пятницу американские фондовые индексы завершили торги в плюсовой зоне, поскольку японские энергетики все же показали прогресс в части охлаждения ядерных реакторов на АЭС Фукусима, да и Правительство Ливии после принятия резолюции ООН заявило о готовности прекратить обстрелы повстанцев. Лидерами спроса в пятницу стали бумаги банковского сектора после того, как ФРС США объявила о завершении стресс-тестов 19 крупнейших американских банков, в результате чего было заявлено о существенном улучшении, как экономических условий, так и состояния капиталов финансовых институтов. Таким образом, ФРС решил ослабить требования к распределению

Полный текст на 2 стр.

Значение основных индексов

	Значение	Δ, день	Δ, нед	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс РТС	1 962,92	0,88%	1,71%	3,90%	25,93%
Индекс ММВБ	1 747,32	0,56%	1,59%	2,03%	21,90%
FTSE	5 718,13	0,39%	-1,90%	-4,93%	1,34%
S&P 500	1 279,20	0,43%	-1,92%	-4,75%	9,72%
Dow Jones Avg.	11 858,52	0,71%	-1,54%	-4,30%	10,01%

Лидеры роста

	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Нижнекамскнефтехим	0,7926	13,22%	4,51%	43,86%
ОГК-4	0,0970	9,60%	6,59%	24,36%
Уфанефтехим	5,2500	5,00%	22,09%	72,13%
Сильвинит	1000,0000	4,49%	2,56%	85,19%
Распадская	7,0500	3,98%	-5,50%	53,36%
Сбербанк	3,5200	3,23%	1,29%	44,86%
Фармстандарт	92,0000	2,22%	-9,63%	26,90%
Лукойл	70,5000	2,17%	6,82%	41,85%

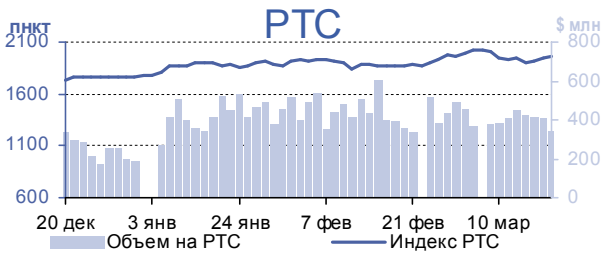
Лидеры снижения

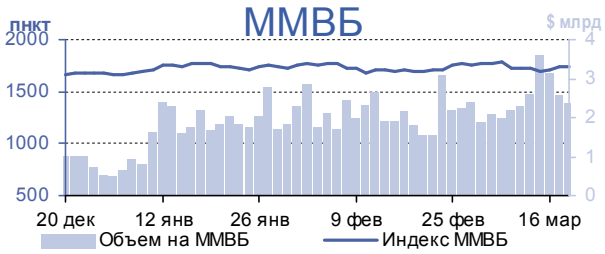
	Цена	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
ОАО Компания М.видео	8,5000	-1,62%	-13,71%	57,41%
ОГК-1	0,0330	-1,49%	-12,00%	-10,81%
Ленэнерго	0,7900	-1,25%	-14,13%	-5,95%

Индекс MSCI

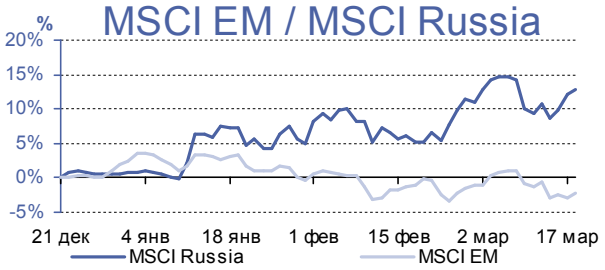
	Значение	Δ, день	Δ, мес	Δ, ytd
Индекс MSCI EM	1098,60	0,66%	-1,95%	9,69%
Индекс MSCI BRAZIL	3611,54	0,87%	-1,44%	1,24%
Индекс MSCI RUSSIA	1043,22	0,73%	5,81%	24,20%
Индекс MSCI INDIA	483,47	-1,26%	-2,68%	-0,50%
Индекс MSCI CHINA	63,81	0,29%	-3,10%	0,40%

Основные индикаторы









Обзор рынка

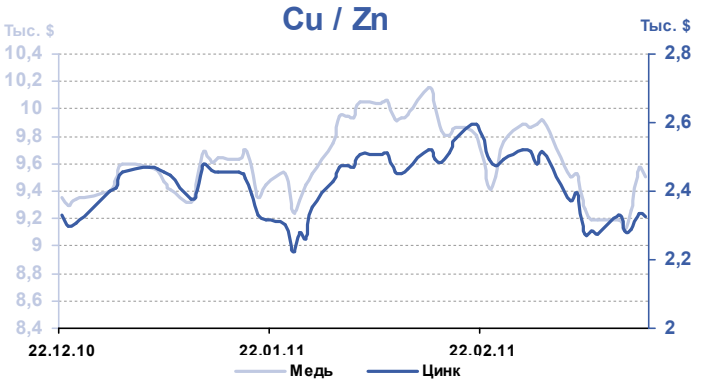
В пятницу американские фондовые индексы завершили торги в плюсовой зоне, поскольку японские энергетики все же показали прогресс в части охлаждения ядерных реакторов на АЭС Фукусима, да и Правительство Ливии после принятия резолюции ООН заявило о готовности прекратить обстрелы повстанцев. Лидерами спроса в пятницу стали бумаги банковского сектора после того, как ФРС США объявила о завершении стресс-тестов 19 крупнейших американских банков, в результате чего было заявлено о существенном улучшении, как экономических условий, так и состояния капиталов финансовых институтов. Таким образом, ФРС решил ослабить требования к распределению банковского капитала, дав возможность местным банкам увеличить объем выплачиваемых дивидендов до 30% от прибыли. Тем не менее, по итогам недели индекс Dow Jones потерял 1,5%, индекс S&P-500 упал на 1,9%, а Nasdaq Composite - на 2,6%.

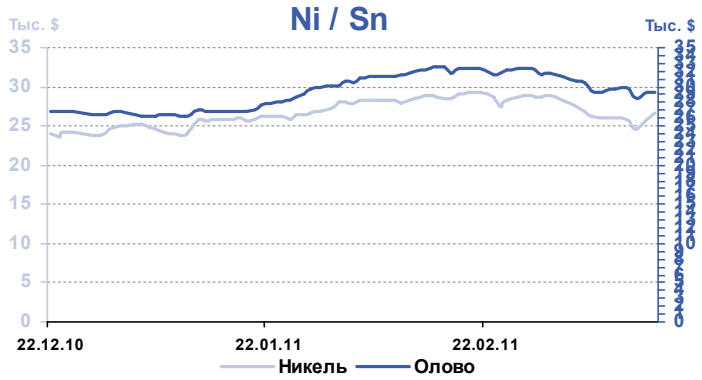
Компании Tokyo Electric Power Co. удалось подключить электропитание к первому и второму реакторам, что позволит усилить доставку воды для охлаждения топливных стержней на АЭС. Реакторы пятого и шестого энергоблоков удалось остудить до безопасного состояния. Все это существенно снизило вероятность ядерной катастрофы в Японии. Сегодня почти все азиатские биржевые индексы торгуются в зеленой зоне (MSCI Asia +1,15%) за исключением Китая, где рынок реагирует на недавнее решение Народного Банка Китая повысить нормы резервирования на 50 базисных пунктов для замедления темпов роста инфляции.

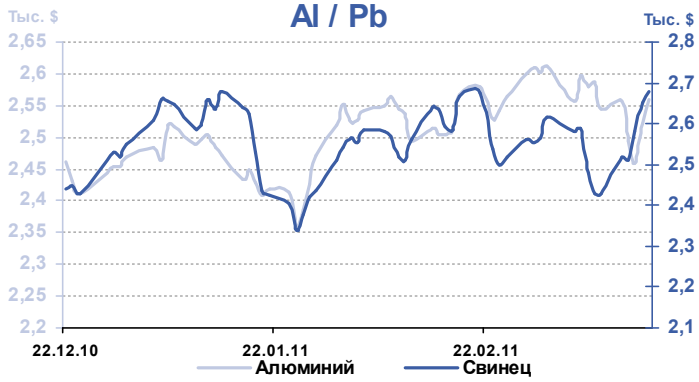
Цены на нефть в эти выходные опять скакнули вверх (Brent $116/барр; WTI $103,2/барр), после того как международная коалиция начала военную операция против режима Каддафи, которая получила название «Одиссея. Рассвет». Надо признать, что массированные авианалеты и запуски ракет не смогли вывести цены на сырье на новые ценовые максимумы. В понедельник утром курс евро против доллара продолжает укрепление (1,4170), поскольку глава ЕЦБ Ж.-К. Трише продолжает сохранять твердое намерение повысить процентную ставку в апреле как минимум на 25 б.п. до 1.25%, даже несмотря на нестабильность рынков из-за природных и техногенных катаклизмов в Японии и растущей конфронтации в Ливии. Возможно, сегодняшнее выступление Ж.-К. Трише (17-00 мск) прольет свет на монетарные действия властей в еврозоне.

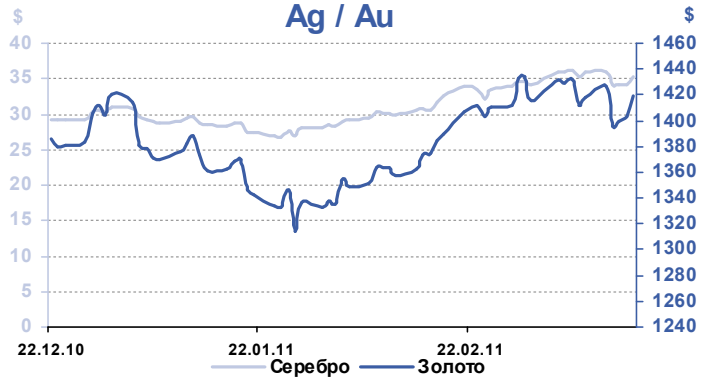
В понедельник наши биржи начнут торги с позитивным настроем. Опять позиции биржевых «быков» будут поддерживать высокие цены на нефть и растущие фьючерсы на американские индексы (S&P +0,73%). Индекс ММВБ получив в пятницу отпор продавцов на уровне 1753 пункта, имеет все шансы на улучшающемся внешнем фоне достичь уровня 1760-65 пунктов. В этой связи, тяжеловесные акции Газпрома и Сбербанка могут оказать хорошую поддержку нашим индексам в их движении наверх. С учетом того, что корпоративный и макроэкономический календарь сегодня почти пуст, все внимание игроков будет сосредоточено на ситуации на рынке нефти и новостях с японских АЭС.

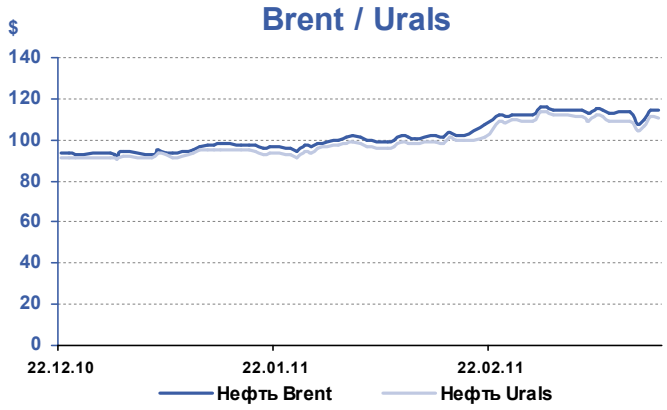
Commodities

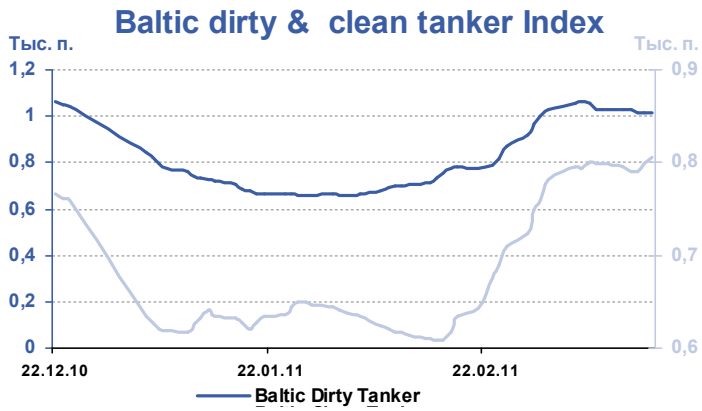












Основные товары, SPOT (LSE, NYSE

	Значение	Δ за день, %	Δ за нед,%	Δ за мес,%	Δ ytd,%
Медь, $/t	9 510,00	-0,58%	3,48%	-3,06%	27,04%
Цинк, $/t	2 325,00	-0,39%	2,20%	-10,44%	-0,39%
Никель, $/t	26 750,00	3,18%	3,08%	-8,70%	17,53%
Олово, $/t	29 400,00	0,09%	-0,34%	-9,12%	65,21%
Алюминий, $/t	2 560,00	1,47%	0,59%	-0,78%	12,48%
Свинец, $/t	2 677,00	0,98%	10,30%	0,07%	19,24%
Серебро, $/oz	35,26	2,92%	-1,82%	4,03%	102,59%
Золото, $/oz	1 418,90	1,08%	0,10%	0,89%	25,86%
Нефть Brent, $/	114,30	-0,44%	1,24%	6,42%	41,92%
Нефть Urals, $/	110,33	-0,71%	0,96%	8,91%	41,98%

Российский рынок акций

Эмитент	Тикер	Цена закрытия, $	Δ РТС	Δ ММВБ	Объем на РТС, $	Объем на ММВБ, $	Капитализация, m$
АшинскийМЗ	AMEZ	0,553	0,00%	1,65%		32 843	273
БашИнСв	BISV	0,509	0,00%	-2,09%		65 637	483
БашЭнрг	BEGY	1,716	0,00%	-1,39%		1 724	1 797
ВМЗ	VSMZ	1675,539	0,00%	0,00%		77 209	2 883
ДВМП	FESH	0,521	0,00%	-1,13%		18 293	1 516
КазанскВЗ	KHEL	3,479	0,00%	0,01%		7 963	533
КОМСТАР	CMST	6,926	0,00%	0,01%		556 482	2 890
Мечел	MTLR	29,883	0,00%	0,00%		1 583 915	12 555
Мотовил	MOTZ	0,091	0,00%	-1,23%		10 212	90
ОАО Банк Москвы	MMBM	40,000	0,00%	0,00%	40 000		7 200
ОАО Выксунский металлург	VSMZ	1730,000	0,00%	0,00%	145 320		2 971
ОАО Мотовилихинские заво	MOTZ	0,088	0,00%	0,00%	52 500		87
ОАО ТНК-ВР Холдинг	TNBP	2,870	0,70%	0,00%	28 700		43 041
СилМашины	SILM	0,329	0,00%	1,33%		114 628	2 826
Сильвинит	SILV	1003,579	0,00%	1,07%		872 362	7 838
СинТЗ-ао	SNTZ	52,735	0,00%	-6,25%		1 494	336
Славн-ЯНОС	JNOS	0,454	0,00%	0,00%		673	419
СТЗ-ао	SVTZ	5,818	0,00%	-4,87%		1 000	283
ТАГМЕТ	TAMZ	0,675	0,00%	-2,78%		408	346
ТНК-ВР	TNBP	2,864	0,00%	-0,65%		529 109	43 313
У-УАЗ	UUAZ	2,285	0,00%	3,75%		80 007	601
ЧМК	CHMK	295,280	0,00%	-0,20%		89 978	942
ЧТПЗ	CHEP	2,953	0,00%	1,08%		112 516	1 399
ЮжКузб.	UKUZ	55,551	0,00%	-0,49%		15 499	1 999
Нефть и газ							
Башнефть	BANE	53,100	0,66%	0,00%	325 515		9 036
Газпром	GAZP	7,950	1,27%	-0,36%	238 500	603 435 556	187 021
Газпромнефть	SIBN	5,109	0,00%	-1,00%		8 482 124	24 613
Лукойл	LKOH	70,500	2,17%	1,16%	35 250	182 013 686	59 965
Мегионнефтегаз	MFGS	17,750	0,00%	0,00%	17 750		1 766
НОВАТЭК	NVTK	12,270	0,00%	0,00%	269 940		37 255
Роснефть	ROSN	8,700	0,00%	-0,46%	514 000	90 040 506	92 204
Сургутнефтегаз	SNGS	1,080	0,00%	-2,89%	108 000	91 030 169	38 584
Сургутнефтегаз, п.	SNGSP	0,543	0,00%	0,32%	325 500	15 080 071	4 182
Татнефть	TATN	6,260	0,00%	0,00%	1 254 500		13 639
Татнефть, п.	TATNP	3,510	0,00%	0,00%	70 200		518
Транснефть, п.	TRNFP	1347,000	0,00%	-0,88%	202 050	17 383 998	2 094
Электроэнергетика							
Иркутскэнерго	IRGZ	0,810	0,00%	1,10%	10 935	37 571	3 861
Ленэнерго	LSNG	0,790	-1,25%	-0,82%	24 710	42 816	732
МОЭСК	MSRS	0,048	0,00%	4,57%	23 750	498 378	2 314
Новосибирскэнерго	NVNG	45,000	0,00%	0,00%	14 985		608
ОГК-2	OGKB	0,049	0,00%	0,00%	24 500		1 604
ОГК-3	OGKC	0,046	0,00%	1,91%	22 750	663 586	2 161
ОГК-4	OGKD	0,097	9,60%	0,00%	283 500		6 116
ОГК-5	OGKE	0,085	0,00%	2,76%		306 101	2 963
ТГК-3	MSNG	0,097	0,00%	-0,14%	46 363	773 589	3 856
ТГК-5	TGKE	0,001	0,00%	-4,42%	324 500	190 462	701
ТГК-6	TGKF	0,000	0,00%	-1,41%	156 557	26 479	894
Телекоммуникации							
Башинформсвязь	BISV	0,450	0,00%	0,00%	45 000		427
ВолгаТелеком	NNSI	5,340	0,00%	0,00%	156 462		1 313
Дальсвязь	ESPK	5,000	0,00%	0,00%	50 000		478
МТС	MTSS	8,950	0,00%	0,00%	195 957		17 840
Ростелеком	RTKM	5,440	-0,18%	-0,73%	219 100	2 382 447	3 964
Ростелеком, п.	RTKMP	3,030	0,00%	-0,28%	15 150	2 808 907	736
СЗТ	SPTL	1,150	0,00%	-0,63%	23 000	301 742	1 013
СибирьТелеком	ENCO	0,100	0,00%	0,00%	10 000		1 201
Таттелеком	TTLK	0,008	0,00%	1,98%		68 210	162
Уралсвязьинформ	URSI	0,053	0,00%	-1,28%		2 274 312	1 713

ЮТК	KUBN	0,230	0,00%	0,00%	11 500		681
Машиностроение							
АвтоВАЗ	AVAZ	1,067	0,00%	7,60%		2 210 762	1 465
ГАЗ	GAZA	50,500	0,00%	0,00%	1 111		935
ИРКУТ	IRKT	0,315	0,00%	-1,21%	31 500	68 227	308
Казанский ВЗ	KHEL	3,250	0,00%	0,00%	32 500		493
КАМАЗ	KMAZ	2,705	0,00%	0,10%		309 687	1 921
Нефтекамский автозавод	nfaz	11,000	0,00%	0,00%	11 000		88
ОМЗ	OMZZ	2,815	0,00%	-1,61%		47 490	100
РКК Энергия	RKKE	334,163	0,00%	2,16%		334	376
Северсталь-авто	SVAV	22,000	0,00%	0,86%	22 000	295 171	754
Металлургия							
АМЗ	AMEZ	0,600	0,00%	0,00%	30 000		299
Бурятзолото	BRZL	32,000	0,00%	0,00%	32 000		225
ВСМПО	VSMO	113,000	0,00%	0,09%	39 450	545 549	1 303
Мечел	MTLR	28,850	0,00%	0,00%	8 655		12 072
ММК	MAGN	1,000	0,00%	2,87%	10 000	3 453 251	11 174
НЛМК	NLMK	4,150	0,00%	-0,43%	18 011	5 195 867	24 872
НорНикель	GMKN	250,000	1,21%	-0,35%	250 000	110 073 905	47 657
Полиметалл	PMTL	17,803	0,00%	-2,22%		1 358 133	7 239
Полюс Золото	PLZL	60,300	0,00%	1,08%	196 681	5 632 697	11 495
Северсталь	CHMF	18,500	0,00%	1,22%	925 000	25 374 352	18 642
ТМК	TRMK	4,570	0,00%	-0,38%		5 825 096	4 303
ЧТПЗ	CHEP	2,931	0,00%	0,00%	439 576		1 384
Банки							
Банк Москвы	MMBM	35,332	0,00%	-0,88%		80 529	6 419
Возрождение	VZRZ	45,000	0,00%	-0,46%	31 500	324 296	1 069
ВТБ	VTBR	0,003	0,00%	0,90%	6 500	91 000 867	33 997
РОСБАНК	ROSB	3,779	0,00%	0,07%		227	2 821
Сбербанк	SBER	3,520	3,23%	0,00%	3 136 300		75 986
УРАЛСИБ	USBN	0,010	0,00%	0,00%	9 500		2 779
Транспорт							
Аэрофлот	AFLT	2,665	0,00%	-2,20%	266 500	1 320 095	2 960
Дальневосточное МП	FESH	0,515	0,00%	0,00%	130 250		1 520
НМТП	NMTP	0,130	0,00%	-2,11%		340 695	2 523
Приморское МП	PRIM	0,182	0,00%	-1,71%		3 635	145
Потребительский рынок							
Аптечная сеть 36,6	APTK	3,000	0,00%	0,00%	240 000		315
Балтика	PKBA	47,500	0,00%	-0,66%	16 625	2 491	7 206
Вимм-Билль-Данн	WBDF	135,000	0,00%	-0,13%	6 750	133 006	5 852
Дикси	DIXY	13,350	1,14%	0,27%	21 360	225 739	1 148
Концерн Калина	KLNA	29,325	0,00%	2,48%	35 190	16 374	286
Красный Октябрь	KROT	11,343	0,00%	0,20%		10 299	103
Магнит	MGNT	130,000	1,64%	2,73%	260 000	2 877 563	11 567
Нутринвестхолдинг	NTRI	2,070	0,00%	-7,70%		276 341	34
Разгуляй	GRAZ	2,350	0,00%	-2,62%	58 846	1 327 641	372
Седьмой континент	SCON	9,500	0,00%	0,00%	11 875		713
Фармстандарт	PHST	92,000	2,22%	0,00%	156 400	33 285	3 477
Черкизово	GCHE	28,650	0,00%	0,49%	231 950	25 124	1 234
Нефтехимия и нефтепереработка							
Казаньоргсинтез	KZOS	0,235	0,00%	0,00%	10 575		420
Нижнекамскнефтехим	NKNC	0,793	13,22%	4,23%	95 108	20 646	1 273
Уфанефтехим	UFNC	5,250	5,00%	0,00%	107 700		1 445
Другие сектора							
МСЗ, Электросталь	MASZ	200,500	0,00%	0,00%	20 050		279
ПИК	pikk	4,580	0,66%	-0,20%	10 002	9 037 352	2 259
РБК ИС	RBCI	1,448	0,00%	-1,25%		692 379	203
Химическая промышленность							
Акрон	AKRN	44,000	0,00%	4,55%	44 000	6 524 767	2 098
Дорогобуж	DGBZ	0,590	0,00%	2,41%	177 000	32 492	425
Сильвинит	SILV	1000,000	4,49%	0,00%	25 000		7 826
Уралкалий	URKA	7,438	0,00%	0,93%	7 438	20 896 558	15 801
Уголь							
Распадская	rasp	7,050	3,98%	3,22%	1 963 400	14 636 015	5 505

УК Южный Кузбасс	UKUZ	52,000	0,00%	0,00%	104 000		1 878

Источник: РТС, Bloomberg

Российские ADR/GDR

Эмитент	Тикер	Акций в АДР	Валюта торгов	Цена закрытия	Изменение, %	Объем, k$
Аэрофлот	AETG		EUR	184,730	-2,11%	35,57
Башнефть	AK6		EUR	183,000	-2,14%	
ALPHABANKSPONSADR	ALBKY		USD	1,890	1,07%	4,44
ТГК-3	AOMD		USD	9,600	-0,52%	14,42
Татнефть	ATAD		USD	41,100	-2,88%	44 971,44
АвтоВАЗ	AVVG		EUR	3,662	7,39%	12,53
Бурятзолото	BYT		EUR	22,000	0,00%	
Башинформсвязь	BYZ		EUR	0,006	0,00%	
Комстар-ОТС	CMST		USD	6,790	-0,15%	7 919,24
ФКЕвразХолдинг	EVR		USD	37,450	1,22%	55 805,37
X5	FIVE		USD	40,500	3,32%	26 593,77
Газпром	GAZ		EUR	22,165	-1,45%	5 347,98
Иркутскэнерго	IRK		EUR	27,000	-3,91%	2,28
ЮТК	KUE		EUR	8,300	-2,35%	
Кузбассэнерго	KUW		EUR	4,000	2,56%	0,87
Kazakhtelecom	KZTA		EUR	6,200	0,00%	
Казаньоргсинтез	KZZ		EUR	1,030	0,98%	17,87
Лукойл	LKOD		USD	70,550	1,95%	506 138,30
Лукойл	LUK		EUR	49,770	0,49%	2 388,07
Лукойл	LUKOY	1	USD	70,800	1,58%	15 010,36
МТС	MBT	5	USD	20,970	-0,33%	82 885,26
МТС	MKY	5	EUR	14,630	-1,08%	
МГТС	MOW		EUR	9,500	0,00%	
ТГК-3	MRO		EUR	6,840	-0,58%	104,74
Мечел	MTL	3	USD	29,550	0,20%	55 084,92
НорНикель	NILSY	1	USD	25,180	0,60%	1 807,24
НорНикель	NNIA		EUR	17,700	-0,59%	311,58
НОВАТЭК	NVTK	1	USD	133,500	1,44%	132 725,20
ВолгаТелеком	NZH		EUR	7,250	0,00%	
Нижнекамскшина	NZK		EUR	1,062	-3,45%	
Нижнекамскнефтехим	OAO		EUR	5,275	0,00%	
Газпром	OGZD		USD	31,460	-0,06%	961 830,90
ОМЗ	OMZD		USD	2,900	0,00%	
ПриморскоеМП	PSK		EUR	5,000	0,00%	
Ростелеком	RKMD		USD	33,000	1,54%	247,40
Ростелеком	RTL		EUR	23,075	0,79%	36,80
Газпромнефть	SCF		EUR	18,300	0,49%	967,54
Сургутнефтегаз	SGN		EUR	7,216	-3,01%	295,20
Сургутнефтегаз	SGNY		EUR	3,809	-0,13%	
Сургутнефтегаз	SGTPY		USD	5,610	1,08%	750,74
Сургутнефтегаз	SGTZY	50	USD	10,400	-2,71%	264,59
АФКСистема	SSA	1	USD	26,850	2,01%	39 385,89
SunInterbrewLtd	SUG		EUR	23,500	0,00%	
SunInterbrewLtdpr.	SUGA		EUR	45,000	0,00%	
СТЗ	SVY		EUR	38,000	-2,56%	3,80
ЦУМ	THT		EUR	20,000	0,00%	
Ютэйр	TYV		EUR	38,000	0,00%	
Ukrnafta	UKAA		EUR	328,350	-3,43%	18,07
Уралсвязьинформ	URL		EUR	7,275	-3,96%	66,70
Уралсвязьинформ	URL1		EUR	5,800	0,00%	8,70
Вымпелком	VIP	1	EUR	13,710	-1,65%	59 256,50
ВТБ	VTBR		USD	6,535	2,03%	111 185,40
Возрождение	VZY		EUR	27,750	2,78%	50,87
Вимм-Билль-Данн	WBD	1	USD	32,940	-0,03%	10 282,02
Вимм-Билль-Данн	WBPA		EUR	23,135	-1,01%	

Источник: Bloomberg

Аналитическая служба «Ай Ти Инвест - Проспект»

Александр Потавин
Начальник отдела, рыночный анализ

Ольга Самарец
Потребительский сектор

Солодин Дмитрий
Ситуационный анализ

Егишянц Сергей
Макроэкономика, мировые рынки

Трейдинг

+ 7 (495) 937 33 63

Лобанов Александр
Начальник отдела
lobjr@prospect.com.ru

Гусев Николай
ngusev@prospect.com.ru

Хмельник Михаил
hop@prospect.com.ru

Билялов Энвер
bilyalov@prospect.com.ru

Кузнецова Ирина
kuznetsova@prospect.com.ru

Зуев Дмитрий
zouev@prospect.com.ru

Синельщикова Екатерина
skat@prsp.ru

Брокерская группа «Ай Ти Инвест -Проспект»

Россия, Москва, 119180, 1-ый Голутвинский переулок, д. 6
телефон: +7 (495) 937 33 63
факс: +7 (495) 937 33 60
www.prsp.ru
www.itinvest.ru

Представленная информация базируется на достоверных источниках.
Тем не менее, содержание данного аналитического обзора может использоваться только в информационных целях.
ОАО "ИК "Проспект" и ЗАО "ИК "Ай Ти Инвест" не несут ответственности за точность предоставленных данных.
Данный документ не является предложением на покупку или продажу каких-либо ценных бумаг.
Он также не является рекомендацией на покупку или продажу ценных бумаг, упомянутых в отчете.
Компании и ее сотрудники, включая тех, кто готовил этот отчет, могут иметь позиции, а также покупать и продавать ценные бумаги упомянутых в отчете компаний.
Инвестирование в странах СНГ является исключительно рискованным, поэтому инвесторы должны самостоятельно тщательно проработать свое решение.

Все права на данный аналитический отчет принадлежат Брокерской группе "Ай Ти Инвест - Проспект".
Перепечатка целиком или отдельными частями без ссылки на компании не допускается.